

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货盘面	IF主力合约 (2512)	4518.2	-13.6↓	IF次主力合约 (2603)	4482.4	-11.2↓
	IH主力合约 (2512)	2958.4	-10.4↓	IH次主力合约 (2603)	2951.2	-10.4↓
	IC主力合约 (2512)	6950.4	-28.8↓	IC次主力合约 (2603)	6781.4	-23.8↓
	IM主力合约 (2512)	7195.4	-41.8↓	IM次主力合约 (2603)	6968.2	-37.2↓
	IF-IH当月合约价差	1559.8	-4.6↓	IC-IF当月合约价差	2432.2	-14.2↓
	IM-IC当月合约价差	245.0	-12.4↓	IC-IH当月合约价差	3992.0	-18.8↓
	IM-IF当月合约价差	2677.2	-26.6↓	IM-IH当月合约价差	4237.0	-31.2↓
	IF当季-当月	-35.8	+3.0↑	IF下季-当月	-84.4	+4.6↑
	IH当季-当月	-7.2	+0.4↑	IH下季-当月	-21.4	-1.4↓
	IC当季-当月	-169.0	+3.4↑	IC下季-当月	-377.8	+1.8↑
	IM当季-当月	-227.2	+4.4↑	IM下季-当月	-464.4	+6.4↑
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-18,212.00	+96.0↑	IH前20名净持仓	-11,672.00	-207.0↓
	IC前20名净持仓	-21,229.00	-403.0↓	IM前20名净持仓	-32,954.00	+280.0↑
现货价格	沪深300	4531.05	-23.3↓	IF主力合约基差	-12.9	+5.7↑
	上证50	2,963.1	-15.4↓	IH主力合约基差	-4.7	+2.4↑
	中证500	6,996.4	-44.0↓	IC主力合约基差	-46.0	+12.1↑
	中证1000	7,248.3	-64.9↓	IM主力合约基差	-52.9	+20.7↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	16,835.56	+762.89↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	24,864.54	+21.43↑
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	1797.60	-500.03↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-2133.0	+793.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-526.51	-686.96↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	26.45	-1.82↓	Shibor (日, %)	1.301	-0.001↓
	IO平值看涨期权收盘价 (2512)	63.40	-11.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	13.33	+0.34↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2512)	44.20	+5.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	13.33	-0.10↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.86	+0.05↑	成交量PCR (%)	73.74	+1.62↑
				持仓量PCR (%)	73.59	+0.94↑
Wind市场强弱分析	全部A股	3.40	-0.10↓	技术面	2.60	-0.20↓
	资金面	4.20	0.00			
行业消息	1、国家统计局发布数据显示, 11月份我国制造业PMI为49.2%, 比上月上升0.2个百分点; 非制造业PMI为49.5%, 比上月下降0.6个百分点; 综合PMI产出指数为49.7%, 比上月下降0.3个百分点。 <div><div>更多观点请咨询!</div></div>					
观点总结	A股主要指数收盘全线下跌。三大指数震荡下行。中小盘股弱于大盘蓝筹股。截止收盘, 上证指数跌0.51%, 深证成指跌0.78%, 创业板指跌1.12%。沪深两市成交额小幅回升。全市场近3900只个股下跌。行业板块普遍下跌, 传媒、计算机板块大幅走弱, 交通运输、有色金属板块领涨。国内方面, 经济基本面, 11月份我国三大PMI指数中, 非制造业PMI与综合PMI均较10月回落, 仅制造业PMI小幅回升, 三大PMI指数均处于收缩区间, 经济整体景气水平回落对市场形成一定压力。整体来看, 11月国内三大PMI均处于收缩区间, 尤其是制造业PMI已连续8个月处于收缩区间, 对市场情绪或将产生一定负面影响。12月上旬, 市场短期仍将处于宏观数据、业绩、政策多重真空期, 在缺乏明确交易指引的环境下, 市场预计还将保持随机游走的态势, 股指将维持震荡。 <div><div>更多资讯请关注!</div></div>					

重点关注	12/3 21:15 美国11月ADP就业人数
	12/4 20:30 美国11月挑战者企业裁员人数; 21:30 美国11月29日当周首次申请失业救济人数
	12/5 23:00 美国11月PCE、核心PCE

数据来源第三方，观点仅供参考。市场有风险，投资需谨慎！

备注：IF:沪深300 IH:上证50 IC:中证500 IM：中证1000 IO:沪深300期权

研究员: 廖宏斌  
期货从业资格号F30825507 期货投资咨询从业证书号Z0020723  
微信号: yanjiufuwu  
电话: 0595-86778969

**免责声明：**本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

瑞达研究